

上海黄金交易所

上金交发〔2012〕129号

关于定期报送《银行业金融机构 场外黄金衍生业务监测表》的通知

各银行业金融机构：

为贯彻落实中国人民银行对银行业金融机构开展场外黄金衍生业务的有关监管要求，根据《中国人民银行办公厅关于加强银行业金融机构黄金市场业务管理有关事项的通知》（银办发〔2012〕238号），现就定期报送《银行业金融机构场外黄金衍生业务监测表》的有关事项通知如下：

一、已经与境内机构开展黄金远期、掉期、期权等场外黄金衍生业务的银行业金融机构应于2013年1月10日前向上海黄金交易所（以下简称“交易所”）报送如下信息：

- （1）场外黄金衍生业务信息报送联系人的信息（附件1）；
- （2）2012年末存续场外黄金衍生业务的逐笔信息（按照附件2《银行业金融机构场外黄金衍生业务监测表》格式提交，通过交易所指定的黄金询价系统达成的交易除外）。

二、已经与境内机构开展黄金远期、掉期、期权等场外黄金

衍生业务的银行业金融机构，自 2013 年 1 月 10 日起，应于每旬前 3 个工作日内提交《银行业金融机构场外黄金衍生业务监测表》，将上旬达成的场外黄金衍生交易逐笔报送交易所，通过交易所指定的黄金询价系统达成的交易除外。

三、尚未与境内机构开展黄金远期、掉期、期权等场外黄金衍生业务的银行业金融机构，应于开展场外黄金衍生业务后的次旬起，按照本通知第二条执行。

四、本通知要求的信息报送工作采用电子报送方式，报送邮箱为 otcderiinfo@sge.com.cn。

联系人：刘建斌

联系电话：021-33667398

附件：

1. 《信息报送联系人信息表》
2. 《银行业金融机构场外黄金衍生业务监测表》



联系人：刘建斌 联系电话：021-33667398 (共印 3 份)

抄 报：中国人民银行金融市场司

上海黄金交易所

2012 年 12 月 31 日印发

附件1:

信息报送联系人信息表

机构名称: _____

一、信息报送联系人信息 (至少两名):

姓名	部门	职务	办公电话	手机	电子邮件	传真

银行业金融机构场外黄金衍生品业务情况表

1. 报送口径：与境内机构开展的场外黄金衍生品业务。
2. 日期格式：YYYYMMDD。
3. 交割品种、挂钩品种：AU99.95、AU99.99 或其他。
4. 交易数量、交易金额：远期、掉期填报时需通过正负标识买卖方向，填表机构买入实物交易数量为正，交易金额为负；卖出实物交易数量为负，交易金额为正。
5. 四舍五入要求：金额保留两位小数。
6. 折算汇率：将美元折算为人民币时，按照报告期末最后一个交易日国家外汇管理局公布的人民币兑美元的基础汇价进行折算。其他外币对美元折算汇率，采用报告期末最后一个交易日上午9时国际外汇市场其他货币兑美元汇率。
7. 折算系数：将盎司折算为克折算系数为1盎司=31.1035克。
8. 期权费金额、费用总额：购买或售出期权、衍生品所支付或收取的费用全额。
9. 其他黄金衍生品填报口径：包括但不限于欧式或美式期权以外的黄金期权、利率互换、结构性黄金衍生品等。
10. 结构说明：说明黄金衍生品的挂钩结构，如交易所认为结构说明不清的，则须提供详细结构条款说明。
11. 期权、黄金衍生品的交易数量、名义本金：按合同约定名义本金或交易数量填报，如合约中仅约定名义本金或交易数量某一项的，另一项按照合同约定的市场价格折算；合约未明确约定市场价格的，按照交易当日 LBMA 午盘黄金定盘价（美元）或交易所黄金结算价（人民币）折算。
12. 其他：本表根据实际情况不定期调整。

银行业金融机构场外黄金衍生品业务情况表

表 1：填表人信息

填报单位：	
填报日期：	
填表人：	
联系电话：	

